

Posudek

vedoucího opponenta
diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Pavol Oravec

Název práce: Finanční deriváty a jejich využití jako zajištění

Jméno vedoucího/opponenta: Jan Hurt

Matematická úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Výsledky:

originální původní i převzaté netriviální kompilace většinou citované z literatury
opsané

Použité metody:

nestandardní standardní obojí

Aplikovatelnost:

přínos pro teorii přínos pro praxi přínos pro praxi i teorii bez přínosu nedovedu posoudit

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet méně podstatné četné závažné

Tiskové chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet četné

Celková úroveň práce:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Práci

doporučuji nedoporučuji

uznat jako diplomovou/bakalářskou. Návrh klasifikace příkládám na zvláštním papíru.

Připomínky a vyjádření vedoucího/oponenta:

Str. 14 Obr. 1.1 Není patrné, jak je myšlen paralelní posun.

Str. 20 Jaký význam má index j u R ?

Str. 22₈ Co se myslí úplností trhu a kde je tento předpoklad uveden?

Str. 22₂₋₁ Co znamená referenční aktivum $\{N_t\}$?

Str. 34¹ Co je „reinvestovaná peněžní jednotka“?

Str. 34²⁻³ Znamená to, že rizikově neutrální pravděpodobnostní míry se liší podle referenčních aktiv? A co se myslí referenčním aktivem?

Str. 34 (2.53) K čemu se zde potřebuje míra Q ?

Str. 38₁₀ Co se myslí „filtrací generovanou Brownovým pohybem“?

Str. 43, poznámka pod čarou: Delta a Gamma jsou citlivosti vzhledem k ceně podkladového aktiva. Citlivost na změnu úrokové míry je obvykle označována jako Rho .

Místo, datum, podpis vedoucího/oponenta: Praha, 26. února 2007

Symbol získáte tak, že vpravo vedle symbolu stisknete klávesu x, symbol pak smaže

